



COELI ASSET MANAGEMENT AB - KVARTAL 3 2017

Information om kapitaltäckning och likviditet

Rapporten innehåller information om kapitaltäckning och likviditet enligt Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2010:7 om hantering och offentliggörande av likviditetsreserver för kreditinstitut och värdepappersbolag samt FFFS 2014:12 om tillsyn och kapitalbuffertar, EU Förordning 575/2013 om tillsyn för kreditinstitut och värdepappersföretag. Lag (2007:528) om värdepappersmarknaden samt Lag 2013:561 om förvaltare av alternativa investeringsfonder (LAIF).

Bolaget har en intern kapital- och likviditetsutvärderingsprocess för att säkerställa att Bolagets kapital täcker alla identifierade risker samt att likviditeten är tillräcklig för att säkra Bolagets kortsiktiga betalningsförmåga.

	2017-09-30	Krav
BELOPP I KSEK		
Kapitalrelationer och buffert		
Total kapitalrelation	14,49%	8,00%
Kärnkapitalrelation	14,49%	4,50%
Primärkapitalrelation	14,49%	6,00%
Kapitalkonserveringsbuffert 2,5%		2,50%
Startkapital och kapitalbas		
Startkapital	1 196	
Kapitalbas		
Aktiekapital	1 750	
Reservfond		
Balanserade vinstmedel	12 663	
Periodens resultat	2 356	
Avdrag ej reviderat resultat	-2 356	
Avdrag uppskjuten skattefordran	-21	
Total Kapitalbas netto	14 392	
Kärnkapital	14 392	
Primärkapital	14 392	
Exponeringar och kapitalkrav		
Alternativ metod fasta omkostnader	Exponeringsbelopp	Kapitalkrav
Baserad på 25 % av fasta omkostnader	99 306	7 945
Kapitalkonserveringsbuffert		2 483
Totalt krav inklusive buffertkrav		10 427
Exponeringsbelopp och kapitalkrav		
Staten	1 939	0
Kreditinstitut	10 202	163
Företag	31 024	2 482
Aktier	0	0
Övriga	5 990	479
Summa kreditrisker (schablonmetod)	49 154	3 124
Marknadsrisker	4 136	331
Summa kredit- och marknadsrisker	53 289	3 455

Uppgifter om kapitalkrav enligt LAIF

125 000 EUR + 0,2 % av fondförmögenhet som överstiger 250 MEUR. Ger kapitalkrav KSEK 2 040.

Likviditet

Likvida tillgångar utgörs av medel på kreditinstitut och beviljade outnyttjade kreditlimiter. Likvidreserven ska uppgå till en månads normala utbetalningar. Likviditeten hanteras gemensamt för hela gruppen. Likvida tillgångar för Bolaget var vid periodens utgång KSEK 10 202.

Coeli Asset Management AB har som AIF-förvaltare ett ytterligare krav att likviditeten ska överstiga kraven i pelare 1. Likviditeten var vid periodens utgång KSEK 10 202 och kravet i pelare 1 var KSEK 9 500.